

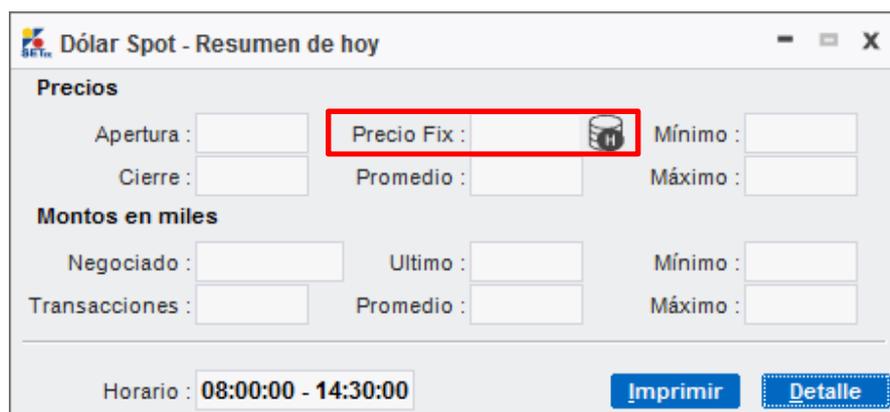
Asunto:

NUEVO CALCULO TASA "PRECIO FIX" - SISTEMA ELECTRÓNICO DE TRANSACCIONES E INFORMACIÓN DEL MERCADO DE DIVISAS SET-FX

SET-ICAP FX S.A, sociedad administradora del Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas SET-FX, se permite informar a todos sus afiliados las siguientes indicaciones sobre el nuevo cálculo de la tasa "precio FIX" implementado en el sistema SET-FX, dando alcance al Boletín Informativo No 276 publicado el 28 de junio de 2019.

Ubicación de la nueva Tasa "Precio FIX"

A continuación se muestra la ventana de resumen de estadísticas del mercado Spot y se señala la ubicación de la nueva tasa precio FIX en el sistema SET-FX:



Dólar Spot - Resumen de hoy			
Precios			
Apertura :	Precio Fix :	Mínimo :	
Cierre :	Promedio :	Máximo :	
Montos en miles			
Negociado :	Ultimo :	Mínimo :	
Transacciones :	Promedio :	Máximo :	
Horario : 08:00:00 - 14:30:00			
		Imprimir	Detalle

La metodología de cálculo para esta nueva tasa "Precio FIX" (Spot USD/COP) será la siguiente:

- Precio promedio ponderado por monto de las operaciones y registros del mercado Spot USD/COP, realizadas entre las 8:00AM y la 1:00PM.
- La nueva tasa "Precio FIX" es calculada a la 1:11PM.
- Se incluyen operaciones entre Intermediarios Cambiarios únicamente.
- Se excluyen las operaciones Spot USD/COP provenientes de registros de derivados.

The screenshot shows a web form titled "Dólar Spot - Registrar transacción". The form contains the following fields and options:

- Hecho por:** Yo (dropdown), Empleados (button), BCLB (dropdown), Mi usuario: JANET (dropdown)
- Clase:** Compra, Venta
- Código:** BBVB (dropdown), B.B.V. A BANCO BILBAO VISCAYA (text field)
- Usuario:** JORGE (dropdown)
- Comentario:** (text field)
- Precio:** 2859.00 (text field)
- Monto:** 1000 m (Miles) (text field)
- Origen:** (dropdown)
- Negociado en:** Spot (selected), Swap O/N contado, Swap Forward, Swap Futuro (dropdown menu)
- Hora:** (text field)
- Buttons:** Enviar, Nuevo, Limpiar

NOTA: la nueva tasa "Precio FIX" es la tasa que se asigna automáticamente a todas las operaciones realizadas a través del módulo FIX del sistema SET-FX.

Nueva Columna "Ori" en la ventana Precios/Montos transados

A partir del 28 de Junio de 2018 se implementó en el sistema la nueva columna "Ori" en la ventana Precios/Montos transados.

En esta columna se identifica el origen de las operaciones registradas o provenientes de otros módulos de acuerdo con la información proporcionada por los IMC en el campo "origen" al momento del registro de la operación:



Sigla	Definición
S	Registros con origen Spot
O	El registro Spot forma parte de un Swap Overnight (O/N)
F	El registro spot es parte de un Swap Forward
U	La operación Spot hace parte de un futuro
W	Cuando la operación Spot proviene del módulo Swap del sistema
FP	Operaciones cerradas a través de la herramienta Matching

La nueva columna puede visualizarse como se indica a continuación:

Hora	Precio	Monto R	Ori
14:45:36	2980.00	250,000 T	
14:45:22	2964.86	1'000,000 F	FP
14:45:00	2951.10	1'000,000 P	
14:00:00	2980.00	750,000 R	S
11:30:00	2950.00	500,000 R	O
11:30:00	2950.00	500,000 R	F
11:30:00	2950.00	500,000 R	U
11:00:00	2950.00	5'000,000 W	W
11:00:00	3000.00	600,000 R	S

Para realizar el cálculo manual del nuevo Precio FIX, se debe descargar el archivo "Precios montos transados de hoy" y filtrar las operaciones teniendo en cuenta la nueva columna origen: "Ori" excluyendo aquellas operaciones identificadas con las letras O,F,U,W.

SET ICAP FX estará en disposición para resolver cualquier inquietud que se pueda presentar sobre este particular y para esto pone a su disposición los siguientes medios:

Conmutador: 7427777

Teléfono: 7427778

Correo: soportesetfx@set-icap.co

(Original Firmado)

ANDRES MACAYA DÁVILA

Presidente